

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos
em julho de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			787.871,25	0,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.337.496,62	4,23%	590	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.064.156,02	5,39%	1.007	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.851.881,46	2,57%	758	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	5.139.394,33	3,43%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	2.646.715,28	1,77%	140	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	143.574,99	0,10%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.377.433,58	0,92%	246	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.564.878,00	1,05%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	3.274.570,00	2,19%	25	1,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.917.279,34	7,29%	984	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.454.522,81	10,99%	1.050	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.155.553,08	6,11%	1.014	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	338.391,29	0,23%	881	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.590.105,91	3,73%	185	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.491.453,22	2,33%	582	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	246.342,85	0,16%	262	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	5.070.149,09	3,39%	687	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.680.757,83	2,46%	148	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.099.080,16	5,41%	709	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

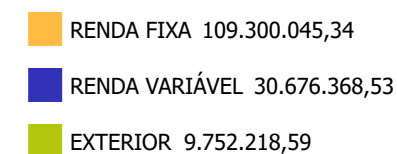
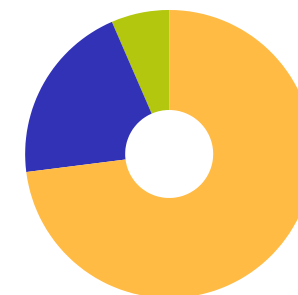
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.763.300,85	3,85%	102	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	769.823,10	0,51%	468	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	D+45 a ...	01/08/2016	1.835.590,57	1,23%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	863.605,66	0,58%	98	1,11%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	3.836.118,05	2,56%	95	1,57%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.419.627,31	2,28%	2.778	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.865.791,93	1,91%	27.293	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.788.308,71	1,86%	59.091	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.576.223,14	1,05%	11.723	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.401.370,00	1,60%	138	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.816.179,67	1,21%	6.091	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	3.873.133,12	2,59%	56	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.270.467,31	1,52%	266	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	1.880.946,64	1,26%	90	1,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.223.687,67	2,82%	3.364	1,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.133.684,36	1,43%	518	1,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTR...	Não se ...	Não se aplica	240.484,01	0,16%	19	0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	6.598,13	0,00%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	421.252,00	0,28%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	S/Info	Não se aplica	387.364,53	0,26%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	371.250,00	0,25%		0,25%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	2.528.354,64	1,69%	13.001	0,12%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	2.634.522,12	1,76%	191	1,08%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.589.341,83	3,07%	454	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			149.728.632,46				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2021)

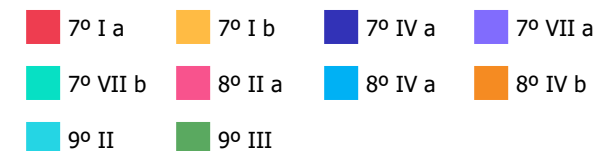
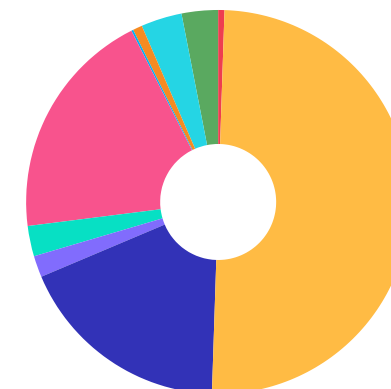
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	787.871,25	0,53%	0,00%	0,53%	0,53%	5.690,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	74.855.952,71	49,99%	10,73%	53,65%	67,07%	25.567.041,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	27.120.907,10	18,11%	3,64%	18,19%	40,00%	32.770.545,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2.699.196,23	1,80%	0,00%	1,81%	1,81%	10.892,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	3.836.118,05	2,56%	0,00%	2,53%	2,53%	-47.983,65
Total Renda Fixa	100,00%	109.300.045,34	73,00%	14,37%	76,71%	111,94%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	29.249.419,86	19,53%	3,65%	18,24%	20,00%	696.306,63
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,09%	3,09%	10,00%	14.972.863,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	247.082,14	0,17%	0,00%	0,11%	0,11%	-82.380,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.179.866,53	0,79%	0,00%	1,13%	1,13%	512.067,02
Total Renda Variável	30,00%	30.676.368,53	20,49%	6,74%	22,57%	31,24%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	5.162.876,76	3,45%	0,00%	0,35%	4,00%	826.268,54
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.589.341,83	3,07%	0,00%	0,35%	6,00%	4.394.376,12
Total Exterior	10,00%	9.752.218,59	6,51%	0,00%	0,70%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	60.177.207,70	40,19	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.064.891,81	29,43	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	18.875.272,17	12,61	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.058.191,41	3,38	0,00
ITAÚ DTVM	3.873.133,12	2,59	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	2.634.522,12	1,76	0,05
VINCI PARTNERS	2.401.370,00	1,60	0,00
META ASSET MANAGEMENT	2.270.467,31	1,52	0,71
WESTERN ASSET	2.133.684,36	1,43	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.880.946,64	1,26	0,20
OLIVEIRA TRUST	1.835.590,57	1,23	0,01
ICATU VANGUARDA	1.816.179,67	1,21	0,00
PETRA CAPITAL	863.605,66	0,58	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	808.616,53	0,54	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	787.871,25	0,53	-
BRZ INVESTIMENTOS	240.484,01	0,16	0,01
PÁTRIA INVESTIMENTOS	6.598,13	0,00	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	10,73	67,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	3,64	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,53
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	18,24	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,09	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,13
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	0,46%	2,34%	1,24%	2,09%	3,66%	9,33%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	0,57%	3,08%	1,57%	2,73%	5,53%	10,89%	-	-
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,10%	-0,44%	0,72%	0,00%	0,96%	8,10%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,25%	-0,93%	0,34%	-0,38%	0,55%	7,68%	1,14%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,18%	1,68%	0,38%	1,54%	5,88%	15,07%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,50%	0,66%	1,32%	5,61%	14,05%	0,88%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	1,50%	0,50%	1,36%	5,46%	14,00%	0,95%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,47%	8,33%	3,86%	7,56%	15,48%	25,26%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,23%	5,60%	3,58%	4,21%	8,93%	11,76%	0,12%	0,05%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,37%	1,01%	0,33%	1,01%	3,03%	14,05%	1,85%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,19%	1,00%	0,60%	0,96%	1,99%	7,60%	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	0,81%	0,59%	0,78%	1,61%	6,90%	0,23%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,03%	1,31%	0,59%	1,21%	5,06%	14,34%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	1,19%	0,52%	1,09%	4,79%	13,79%	1,02%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	2,90%	1,78%	2,60%	6,99%	16,37%	0,42%	0,01%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	-0,02%	0,66%	0,44%	0,68%	4,16%	13,29%	1,05%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	1,17%	0,53%	1,08%	4,77%	13,71%	1,00%	0,02%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,01%	1,20%	0,53%	1,11%	4,82%	13,88%	1,00%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	-0,37%	-1,09%	1,10%	-0,24%	2,53%	10,89%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,39%	-1,21%	1,07%	-0,36%	2,22%	10,14%	2,05%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	2,86%	1,76%	2,56%	6,53%	12,65%	0,42%	0,01%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,58%	-5,74%	0,92%	-4,37%	-3,96%	1,38%	2,57%	0,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,40%	-1,23%	1,04%	-0,36%	2,28%	10,19%	2,05%	0,06%

CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,39%	1,72%	1,01%	1,55%	2,51%	6,34%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	1,61%	1,00%	1,45%	2,41%	6,22%	0,05%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,20%	-4,40%	-3,74%	-4,21%	1,26%	-9,80%	0,04%	0,08%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,38%	1,89%	1,07%	1,71%	2,83%	6,19%	0,01%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,11%	-0,50%	0,54%	-0,04%	1,16%	-	1,10%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	1,97%	1,23%	1,82%	5,59%	13,55%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,78%	-0,06%	-0,54%	-0,09%	0,90%	10,67%	1,68%	0,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,28%	1,10%	0,92%	1,06%	1,27%	7,76%	0,22%	0,01%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	14,23%	0,22%	7,98%	30,62%	103,08%	7,99%	0,17%

IBX (Benchmark)	-3,99%	4,47%	2,33%	7,73%	20,73%	23,34%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-5,59%	-6,27%	-2,74%	-0,15%	2,64%	15,97%	8,94%	0,21%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-6,23%	-1,63%	-0,08%	3,11%	4,40%	2,72%	9,72%	0,19%

Ibovespa (Benchmark)	-3,94%	2,34%	2,44%	5,85%	18,35%	19,63%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,32%	2,10%	2,44%	8,14%	24,15%	24,17%	8,21%	0,25%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,78%	2,87%	2,04%	8,25%	23,66%	34,95%	8,28%	0,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-4,45%	7,96%	-2,22%	11,50%	18,84%	30,73%	8,76%	0,20%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-6,11%	-13,27%	-3,14%	-6,67%	-13,31%	-19,25%	10,93%	0,29%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,27%	1,09%	1,33%	4,37%	13,07%	26,07%	8,94%	0,21%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,91%	-1,81%	-0,54%	2,20%	6,58%	1,88%	7,63%	0,21%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-4,55%	1,24%	0,92%	3,66%	14,33%	19,32%	8,24%	0,20%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	-4,14%	-1,64%	2,73%	1,46%	9,91%	6,32%	8,87%	0,19%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	-3,98%	-1,34%	1,24%	2,67%	10,07%	14,81%	8,63%	0,18%

IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,76%	10,38%	4,72%	9,31%	19,26%	33,65%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	0,81%	63,21%	63,91%	63,38%	28,94%	28,15%	1,40%	0,63%

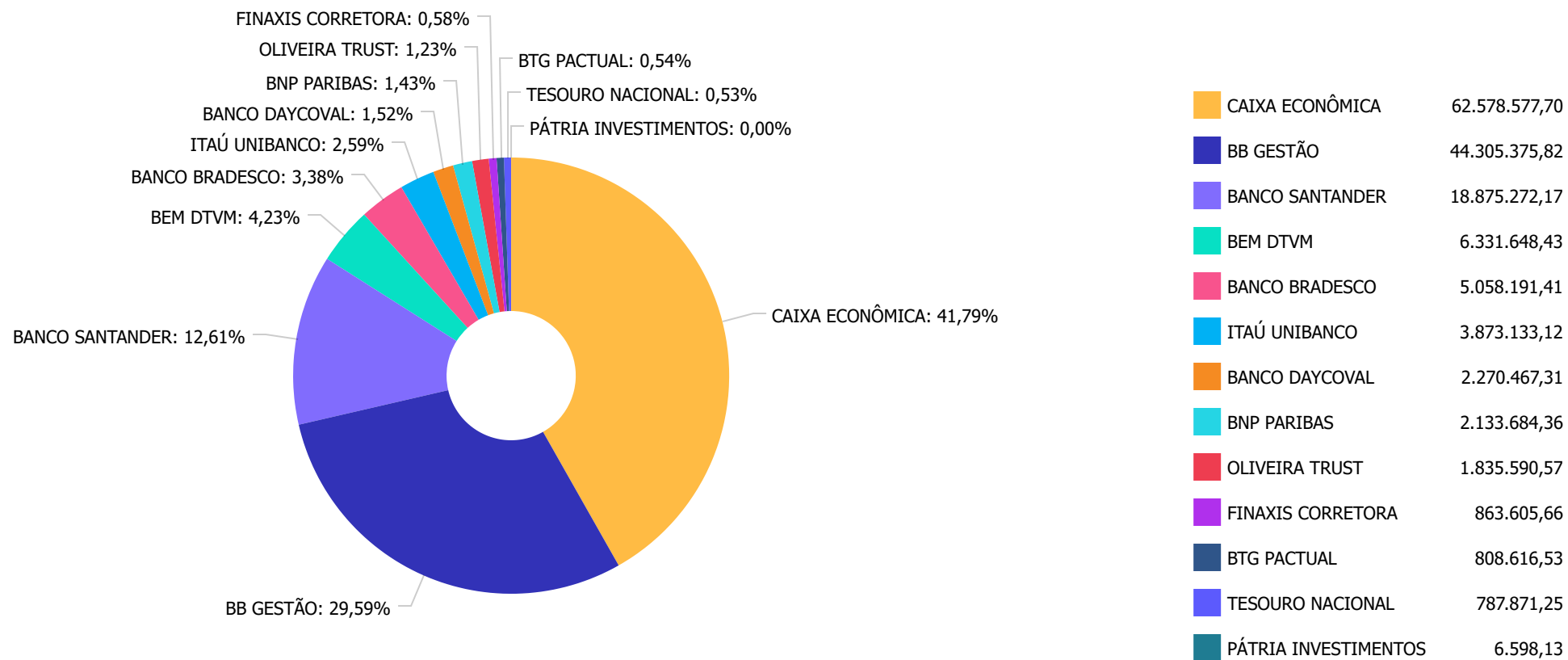
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	-0,80%	-24,15%	-11,57%	-15,22%	-29,73%	-99,81%	-	-
IFIX (Benchmark)	2,51%	-1,60%	-1,29%	-1,92%	3,33%	6,19%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-11,36%	-45,74%	-21,84%	-34,93%	-57,08%	-31,06%	9,70%	0,35%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	0,01%	-8,71%	-5,21%	-9,89%	-10,98%	-16,60%	6,95%	0,12%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	2,24%	-14,35%	-7,40%	-13,49%	-6,48%	0,86%	8,29%	0,14%

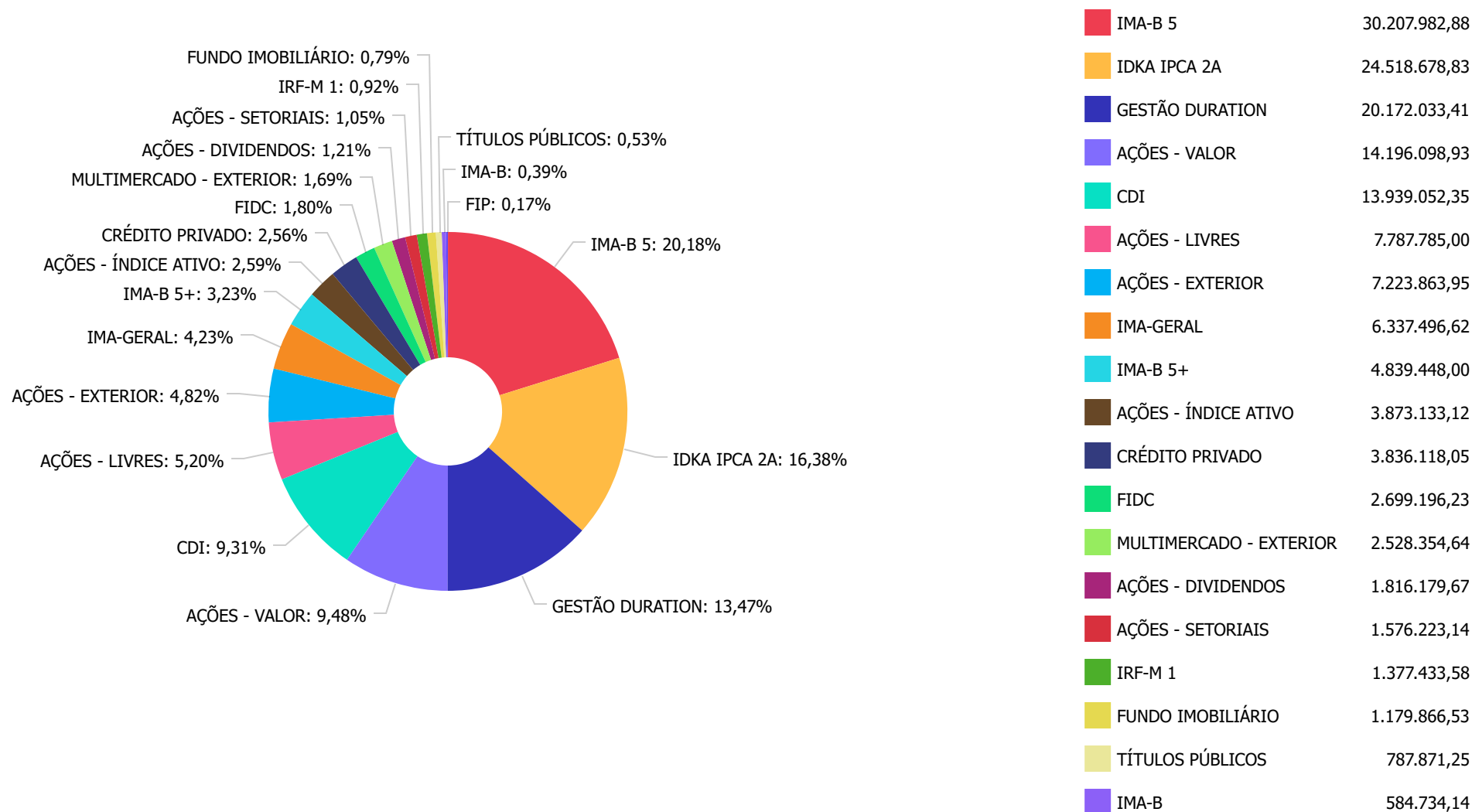
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	14,23%	0,22%	7,98%	30,62%	103,08%	7,99%	0,17%
MSCI WORLD (Benchmark)	4,15%	12,45%	-1,01%	7,85%	31,07%	90,86%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	5,20%	12,97%	-1,36%	6,94%	32,38%	107,65%	7,57%	0,15%
MSCI ACWI (Benchmark)	2,99%	10,44%	-2,20%	5,36%	29,16%	87,89%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6,34%	16,25%	0,63%	9,39%	-	-	7,80%	-

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Julho / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Julho / 2021)



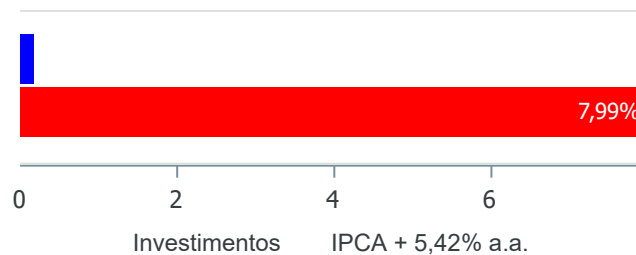
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/06/2004	201	1.451,706521	3.919,757461	291.793,01	787.871,25	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

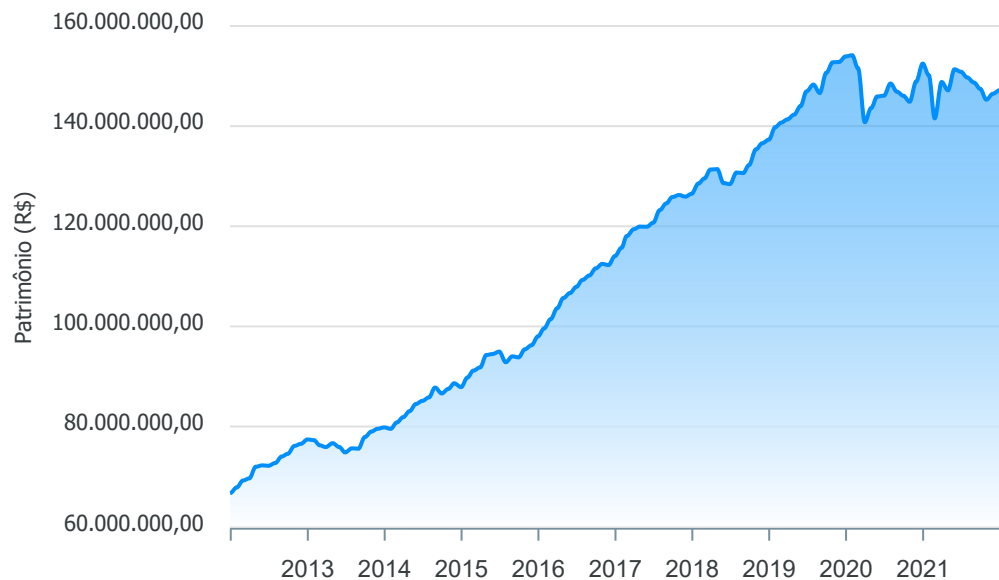
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	152.485.447,41	4.643.906,46	5.554.646,47	150.161.392,77	-1.413.314,63	-1.413.314,63	-0,93%	-0,93%	0,67%	0,67%	-138,16%	3,59%
Fevereiro	150.161.392,77	8.750.580,11	15.316.072,86	141.569.937,35	-2.025.962,67	-3.439.277,30	-1,35%	-2,26%	1,24%	1,92%	-117,88%	3,40%
Março	141.569.937,35	7.733.552,70	2.184.069,62	148.804.106,65	1.684.686,22	-1.754.591,08	1,15%	-1,14%	1,42%	3,36%	-34,01%	3,81%
Abril	148.804.106,65	3.572.270,11	6.533.833,64	147.158.014,53	1.315.471,41	-439.119,67	0,88%	-0,27%	0,73%	4,12%	-6,56%	2,56%
Mai	147.158.014,53	14.627.232,63	12.313.797,07	151.354.327,80	1.882.877,71	1.443.758,04	1,26%	0,99%	1,27%	5,45%	18,10%	2,77%
Junho	151.354.327,80	2.418.567,25	2.536.807,64	150.871.362,74	-364.724,67	1.079.033,37	-0,24%	0,74%	0,97%	6,47%	11,47%	2,41%
Julho	150.871.362,74	8.051.768,23	8.337.574,17	149.728.632,46	-856.924,34	222.109,03	-0,57%	0,17%	1,43%	7,99%	2,13%	2,99%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



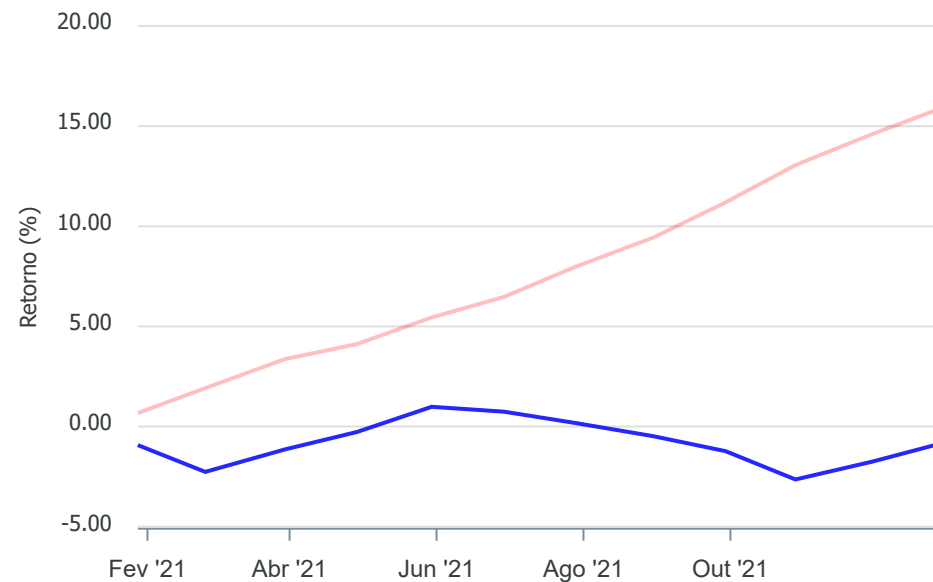
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.545.802,00	0,00	0,00	1.564.878,00	19.076,00	1,23%	1,23%	0,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.105.606,94	0,00	0,00	5.139.394,33	33.787,39	0,66%	0,66%	0,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	142.639,69	0,00	0,00	143.574,99	935,30	0,66%	0,66%	0,42%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	1.825.147,32	0,00	0,00	1.835.590,57	10.443,25	0,57%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.636.121,96	0,00	0,00	2.646.715,28	10.593,32	0,40%	0,40%	0,63%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.397.355,47	1.399.721,36	733.234,92	8.099.080,16	35.238,25	0,40%	0,45%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.052.391,90	0,00	2.104,39	5.070.149,09	19.861,58	0,39%	0,39%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	5.747.090,78	0,00	0,00	5.763.300,85	16.210,07	0,28%	0,28%	0,22%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.374.799,65	0,00	0,00	1.377.433,58	2.633,93	0,19%	0,19%	0,23%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	962.497,85	740.046,87	935.610,63	769.823,10	2.889,01	0,17%	0,38%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.057.431,32	0,00	0,00	8.064.156,02	6.724,70	0,08%	0,08%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.851.011,78	0,00	0,00	3.851.881,46	869,68	0,02%	0,02%	1,02%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	6.324.605,25	0,00	735.863,74	5.590.105,91	1.364,40	0,02%	0,01%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.154.280,61	0,00	0,00	9.155.553,08	1.272,47	0,01%	0,01%	1,00%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.681.439,42	0,00	0,00	3.680.757,83	-681,59	-0,02%	-0,02%	1,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.465.214,95	0,00	0,00	16.454.522,81	-10.692,14	-0,06%	-0,06%	0,95%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.495.339,07	0,00	0,00	3.491.453,22	-3.885,85	-0,11%	-0,11%	1,10%
TÍTULOS PÚBLICOS	789.164,17	0,00	0,00	787.871,25	-1.292,92	-0,16%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	865.362,01	0,00	0,00	863.605,66	-1.756,35	-0,20%	-0,20%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.353.358,10	0,00	0,00	6.337.496,62	-15.861,48	-0,25%	-0,25%	1,14%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	3.850.451,53	0,00	0,00	3.836.118,05	-14.333,48	-0,37%	-0,37%	1,85%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	247.296,95	0,00	0,00	246.342,85	-954,10	-0,39%	-0,39%	2,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	339.745,65	0,00	0,00	338.391,29	-1.354,36	-0,40%	-0,40%	2,05%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.293.650,00	0,00	0,00	3.274.570,00	-19.080,00	-0,58%	-0,58%	2,57%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.002.617,93	0,00	0,00	10.917.279,34	-85.338,59	-0,78%	-0,78%	1,68%
Total Renda Fixa	109.560.422,30	2.139.768,23	2.406.813,68	109.300.045,34	6.668,49	0,01%		0,91%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	146.353,81	0,00	2.730,84	240.484,01	96.861,04	66,18%	0,81%	1,40%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	378.895,95	0,00	7.057,15	387.364,53	15.525,73	4,10%	2,24%	8,29%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	421.200,00	0,00	7.176,00	421.252,00	7.228,00	1,72%	0,01%	6,95%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	6.598,13	0,00	0,00	6.598,13	0,00	0,00%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	9.511.140,64	0,00	5.912.000,00	3.419.627,31	-179.513,33	-1,89%	-2,32%	8,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	2.956.000,00	0,00	2.865.791,93	-90.208,07	-3,05%	-2,78%	8,28%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	2.222.015,03	0,00	0,00	2.133.684,36	-88.330,67	-3,98%	-3,98%	8,63%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	4.406.087,28	0,00	0,00	4.223.687,67	-182.399,61	-4,14%	-4,14%	8,87%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.508.530,91	0,00	0,00	2.401.370,00	-107.160,91	-4,27%	-4,27%	8,94%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.057.620,95	0,00	0,00	3.873.133,12	-184.487,83	-4,55%	-4,55%	8,24%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.910.042,90	0,00	0,00	1.816.179,67	-93.863,23	-4,91%	-4,91%	7,63%
META VALOR FI AÇÕES	2.404.795,44	0,00	0,00	2.270.467,31	-134.328,13	-5,59%	-5,59%	8,94%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	2.956.000,00	0,00	2.788.308,71	-167.691,29	-5,67%	-4,45%	8,76%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.678.750,97	0,00	0,00	1.576.223,14	-102.527,83	-6,11%	-6,11%	10,93%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.005.846,78	0,00	0,00	1.880.946,64	-124.900,14	-6,23%	-6,23%	9,72%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	418.850,00	0,00	1.796,50	371.250,00	-45.803,50	-10,94%	-11,36%	9,70%
Total Renda Variável	32.076.728,79	5.912.000,00	5.930.760,49	30.676.368,53	-1.381.599,77	-3,64%		8,65%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Julho / 2021)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	2.477.418,89	0,00	0,00	2.634.522,12	157.103,23	6,34%	6,34%	7,80%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.353.372,73	0,00	0,00	4.589.341,83	235.969,10	5,42%	5,42%	7,99%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.403.420,03	0,00	0,00	2.528.354,64	124.934,61	5,20%	5,20%	7,57%
Total Exterior	9.234.211,65	0,00	0,00	9.752.218,59	518.006,94	5,61%		7,83%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.